

Fecha de Publicación: 19 de marzo de 2014

Fecha de Información: 17 de marzo de 2014 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1085,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	136,6	133,9	54,7	37,0	12,2	32,6	67,0
15-35	375,8	313,4	265,9	183,4	14,5	159,3	33,0
36-60	35,6	32,7	0,9	0,0	23,2	27,0	8,6
61-90	65,8	14,2	0,0	1,0	14,1	64,8	0,0
91-180	17,5	30,1	0,3	0,0	29,8	17,5	0,0
>180	21,8	21,6	0,0	14,6	16,6	2,2	5,0
Total	653,0	545,9	321,9	236,0	110,4	303,4	113,6

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,7 %	3,1 %	2,2 %	2,6 %
15-35	2,7 %	2,6 %	2,8 %	2,7 %
36-60	2,6 %	3,4 %	2,7 %	2,9 %
61-90	-	3,3 %	2,4 %	2,6 %
91-180	-	3,0 %	2,9 %	3,0 %
>180	3,0 %	3,3 %	3,1 %	3,2 %
Total	2,7 %	2,8 %	2,7 %	2,7 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	17 al 21 de marzo				24 al 28 de marzo				31 de mar. al 4 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	87	4876	5380	12	85	1918	2230	17	50	2191	2261
Intragrupo y off-shore***	4	0	3728	2330	0	0	1116	289	0	0	1287	904
Otros	83	20	401	1294	85	12	593	1109	50	17	377	690
Total	107	107	9004	9004	97	97	3627	3627	67	67	3855	3855

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

1

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.